海富通风格优势股票型证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008年12月31日

基金管理人：海富通基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 送出日期：2009年3月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通优势
交易代码	519013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月19日
报告期末基金份额总额	3,274,034,712.14份

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下，通过积极选择不同风格优势的股票，力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
投资策略	本基金将在适度的大类资产配置的基础上，运用“风格优选，积极轮换，精选个股”策略，把握不同风格优势策略在不同阶段的变动趋势和投资机会，并在策略内自下而上精选个股，实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要包括资产配置策略、风格轮换策略和精选证券策略。
业绩比较基准	75%MSCI China A＋25%上证国债
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	尹东
	联系电话	021-38650891	010-67595003
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-50479057	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-860,222,072.55	5,112,411,269.07	173,231,242.55
本期利润	-3,769,490,381.52	6,875,178,311.35	786,818,251.33
加权平均基金份额本期利润	-1.0178	1.0271	0.3447
本期基金份额净值增长率	-56.27%	111.65%	34.80%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.2965	0.7817	0.0768
期末基金资产净值	2,303,120,174.47	7,846,698,189.14	2,726,832,179.40
期末基金份额净值	0.703	1.977	1.348

注：1、本基金合同生效日为2006年10月19日，2006年度主要财务指标的计算期间为2006年10月19日至2006年12月31日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

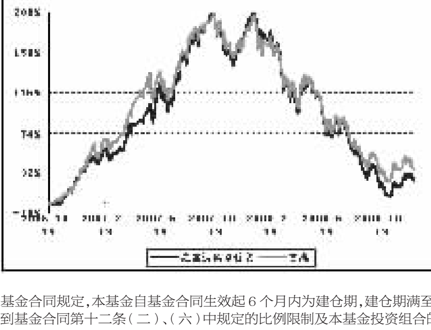
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-11.35%	2.13%	-11.34%	2.21%	-0.01%	-0.08%
过去六个月	-28.73%	2.33%	-24.29%	2.16%	-4.44%	0.17%
过去一年	-56.27%	2.45%	-51.83%	2.21%	-4.44%	0.24%
自基金合同生效起至今	24.78%	2.10%	35.39%	1.95%	-10.61%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通风格优势股票型证券投资基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年10月19日至2008年12月31日）



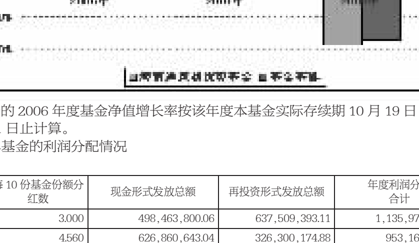
注：

（1）根据基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，建仓期满至今，本基金的各项投资比例应达到基金合同第十二条（二）、（六）中规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

（2）为了能更公允地体现基金投资业绩，海富通基金管理有限公司自2007年1月1日起调整海富通优势基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为MSCI China A指数，相应的基准权重不变。

3.2.3 本基金自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通风格优势股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：图中列示的2006年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期10月19日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	3.000	498,463,800.06	637,509,393.11	1,135,973,193.17	
2007年	4.560	626,860,643.04	326,300,174.88	953,160,817.92	
2006年	-	-	-	-	
合计	7.560	1,125,324,443.10	963,809,567.99	2,089,134,011.09	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司于2003年4月1日共同发起设立。本海富通风格优势股票型证券投资基金是基金管理人管理的第六只开放式基金；除本基金外，基金管理人目前还管理着海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金和海富通稳健添利债券型证券投资基金八只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
康赛波	本基金的基金经理；	2007-8-6	—	12年	金融学士，持有基金从业人员资格证书。1997年至1999年工作于湘财证券有限责任公司，主要从事投资管理业务；1999年至2000年工作于大成基金管理有限公司，从事研发及投资管理业务；2001年2月起加入湘财合丰基金管理公司筹备组，2003年4月至2005年4月任泰达荷银合丰稳定基金基金经理；2005年4月至2006年12月担任泰达荷银风险预算股票基金基金经理；2006年5月至2007年4月担任泰达荷银效率基金基金经理；2007年5月加入海富通基金管理有限公司，2007年8月起任海富通优势基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立有公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，并进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

2008年，上证指数的跌幅达到65%，创下了有史以来的最大年跌幅，超过了同期香港恒生指数和美国道琼斯指数的跌幅。市场出现单边下跌主要是由于投资者对全球金融危机和国内宏观经济形势变化、上市公司盈利预期下滑的担忧所致。08年上半年美国次贷危机逐步扩散，国际油价屡创新高，国内通货膨胀形势严峻，而到了下半年随着国际金融市场危机迅速恶化，全球经济增长快速下滑。我国宏观政策目标也由上半年的抑制通胀转变为大力刺激内需以保持经济稳定增长。九月份央行四年来首次下调人民币贷款利率，开始了降息的步伐，并且取消了银行信贷额度上限。管理层也开始救市，出台了印花税单边征收等利好，但市场依旧被悲观气氛笼罩，没有止住下跌的步伐，十月份上证指数出现了1994年8月以来的最大月跌幅。十一月国务院推出促进经济增长的十项措施，并宣布将在2010年底前共投资4万亿元，股市开始止跌企稳，市场信心有所恢复。

2008年初，由于对次债可能引发的金融危机的预判估计不足，低估了国际经济动荡对国内的冲击，本基金保持着较高的资产配置比例，尤其是银行、地产类，导致组合业绩受到较大的影响。随着二季度国内经济下滑趋势确认，本基金减持了金融地产类资产，增持了防御性较强的医药以及依靠内需为主的软件服务行业。下半年由于配置了较多的食品饮料和商业零售等资产，出现了一定的补跌行情，但四季度随着国家四万亿投资计划的推出，本基金及时增持了国家重点投资的领域如电力设备、铁路建设及机械设备类公司，从十月下旬开始，市场反弹行情逐级展开，很多行业如工程机械、电气设备、建筑建材等出现较大幅度的反弹，使本基金取得了较好的收益，但整体上，全年行业及个股投资机会的挖掘和把握上还是做得很不够。

本报告期内，基金净值增长率为-56.27%，而同期基金业绩比较基准收益率为-51.83%，基金净值落后业绩比较基准4.44个百分点，主要原因是报告期内对市场下跌估计不足，资产配置比例较高。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二零零九年中国经济依然面临不确定性，但随着中央政府经济刺激政策陆续落实，加之银行信贷集中于年初发放的惯例，一二季度宏观经济有望相对于二零零八年第四季度的“停摆”状态有所复苏，由此将为A股市场带来一些阶段性的机会。我们谨慎看待下半年的经济刺激政策实现的力度和效果，但是仍对国家在更深更广的领域内刺激经济，落实各大产业复兴政策的举措和力度怀有期待。基于上述判断，海富通风格优势基金将重点关注以下投资机会：一是将受益于经济复苏的周期类公司，很多历史上质地优秀、核心竞争优势明显、能够在经济低谷时扩大市场份额提高产业地位的公司，在这一轮恢复性上涨过程中，应该得到业绩和估值的提升；二是符合国家产业政策方向的细分行业和公司，如新能源产品提供商等，这些公司尽管目前收入和利润有限，但是能够持续获得国家的政策支持和扶持；三是估值相对市场折价的金融类公司；四是能够在宏观经济波动过程中保持稳定增长的细分行业和公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司业务管理委员会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

已实施的利润分配：本基金于2008年3月6日宣告第二次分红，向截至2008年3月5日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额2元派发现金红利。共发放红利740,385,267.25元，其中2008年3月6日以红利再投资形式发放435,402,649.91元，2008年3月7日以现金形式发放304,982,617.34元。

本基金于2008年7月16日宣告第三次分红，向截至2008年7月15日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额1元派发现金红利。共发放红利395,587,925.92元，其中2008年7月16日以红利再投资形式发放202,106,743.20元，2008年7月17日以现金形式发放193,481,182.72元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，中国建设银行股份有限公司按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例并及时通知了基金管理人，对基金份额持有人利益未造成损害。

5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国建设银行股份有限公司复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通风格优势股票型证券投资基金

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产：		
银行存款	529,229,333.08	101,104,485.87
结算备付金	4,248,085.93	4,579,305.69
存出保证金	827,609.18	3,372,356.74
交易性金融资产	1,794,188,954.09	7,343,321,373.41
其中：股票投资	1,794,188,954.09	6,816,869,373.41
基金投资	-	-
债券投资	-	526,452,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	218,973,800.00
买入返售金融资产	-	200,000,420.00
应收证券清算款	9,698,751.60	17,101,940.63
应收利息	119,286.16	13,522,417.25
应收股利	-	-
应收申购款	57,335.82	6,342,747.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,338,369,355.86	7,908,318,846.87
负债和所有者权益	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	22,033,023.39	-
应付赎回款	5,348,003.55	44,676,210.02
应付管理人报酬	2,993,356.87	9,432,379.73
应付托管费	498,892.80	1,572,063.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,867,342.95	4,476,700.05
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,508,561.83	1,463,304.63
负债合计	35,249,181.39	61,620,657.73
所有者权益：		
实收基金	3,274,034,712.14	3,969,972,851.31
未分配利润	-970,914,537.67	3,876,725,337.83
所有者权益合计	2,303,120,174.47	7,846,698,189.14
负债和所有者权益总计	2,338,369,355.86	7,908,318,846.87

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值0.703元，基金份额总额3,274,034,712.14份。

7.2 利润表

会计主体：海富通风格优势股票型证券投资基金

本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-3,645,374,689.95	7,146,623,182.26
1.利息收入	10,034,165.05	30,346,010.22
其中：存款利息收入	4,269,174.38	11,117,116.06
债券利息收入	3,988,202.65	12,940,393.69
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,776,788.02	6,288,500.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-748,582,165.08	5,333,873,700.71
其中：股票投资收益	-866,270,281.09	5,206,883,731.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	348,759.68	1,955,139.87
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	93,582,007.66	79,709,793.36
股利收益	23,757,348.67	45,325,036.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,909,268,308.97	1,762,767,042.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,441,619.05	19,636,429.05
二、费用（以“-”号填列）	-124,115,691.57	-271,444,870.91
1. 管理人报酬	-65,694,892.46	-140,696,324.98
2. 托管费	-10,949,148.81	-23,449,387.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-46,233,320.24	-99,627,032.09
5. 利息支出	-711,446.81	-7,072,316.89
其中：卖出回购金融资产支出	-711,446.81	-7,072,316.89
6. 其他费用	-526,883.25	-599,809.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,769,490,381.52	6,875,178,311.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,769,490,381.52	6,875,178,311.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通风格优势股票型证券投资基金

本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,969,972,851.31	3,876,725,337.83	7,846,698,189.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,769,490,381.52	-3,769,490,381.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-695,938,139.17	57,823,699.19	-638,114,439.98
其中：1.基金申购款	1,450,821,925.77	418,105,437.76	1,868,927,363.53
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-2,146,760,064.94	-360,281,738.57	-2,507,041,803.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,135,973,193.17	-1,135,973,193.17
五、期末所有者权益（基金净值）	3,274,034,712.14	-970,914,537.67	2,303,120,174.47
项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,023,268,021.61	703,564,157.79	2,726,832,179.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,875,178,311.35	6,875,178,311.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	1,946,704,829.70	-2,748,856,313.39	-802,151,483.69
其中：1.基金申购款	14,092,376,546.07	780,773,044.74	14,873,149,590.81
2.基金赎回款	-12,145,671,716.37	-3,529,629,358.13	-15,675,301,074.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-953,160,817.92	-953,160,817.92
五、期末所有者权益（基金净值）	3,969,972,851.31	3,876,725,337.83	7,846,698,189.14

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

报告期内不存在会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自2008年9月16日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法，从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调6,634,830.00元，相应调减本基金的净利润6,634,830.00元和基金资产净值6,634,830.00元。

7.4.1.3 差错更正的说明

报告期内不存在重大会计差错。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
富通基金管理公司 (Fortis Investment Management S.A.)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,793,681,136.49	10.74%	11,436,040,647.18	32.28%

7.4.3.1.2 权证交易

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	285,153,190.96	62.04%

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	1,473,388.30	10.38%	314,991.44	11.00%
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	9,483,161.86	32.71%	874,855.78 874,855.78	19.57%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	65,694,892.46	140,696,324.98
其中：当期已支付	62,701,535.59	131,263,945.25
期末未支付	2,993,356.87	9,432,379.73

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理费是按前一日基金资产净值的年费率（1.5%）计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费＝前一日基金资产净值X 1.5%/当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	10,949,148.81	23,449,387.45
其中：当期已支付	10,450,256.01	21,877,324.15
期末未支付	498,892.80	1,572,063.30

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值的年费率（0.25%）计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值X 0.25%/当年天数

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	30,010,972.60	149,864,303.42	-	-	-	-
上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	123,151,152.33	-	-	510,000,000.00	197,162.80

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
建设银行	529,229,333.08	4,111,407.41	101,104,485.87	10,601,100.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2008年1月1日至2008年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/手）	总金额
海通证券	601898	中煤能源	首次公开发行	149,607	2,517,885.81
上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/手）	总金额
海通证券	601601	中国太保	首次公开发行	271,465	8,143,950.00
海通证券	126005	07武钢债	公开发行	46,376	46,376,000.00
海通证券	601168	西部矿业	首次公开发行	244,607	3,297,302.36
海通证券	601919	中国远洋	首次公开发行	352,030	2,985,214.40
海通证券	601808	中海油服	首次公开发行	283,200	3,817,536.00
海通证券	601005	重庆钢铁	首次公开发行	1,014,000	2,920,320.00

注：上述承销证券中，股票的数量单位为股，债券的数量单位为手。

7.4.4 期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
000768	西飞国际	08/02/22	09/02/25	非公开发行	25.18	12.49	6,500,000	163,670,000.00	81,185,000.00
000401	冀东水泥	08/06/30	09/07/01	非公开发行	11.83	9.90	4,000,000	47,320,000.00	39,600,000.00
600583	海油工程	08/12/31	09/12/31	非公开发行	11.55	11.57	3,000,000	34,650,000.00	34,710,000.00

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
000652	泰达股份	08/12/30	资产重组	5.33	09/01/20	5.28	2,999,971	17,108,862.01	15,989,845.43
000792	盐湖钾肥	08/06/26	资产重组	56.78	08/12/26	78.23	304,350	26,617,534.10	17,280,993.00

注：本基金期末持有的青海盐湖钾肥股份有限公司股票自2008年12月26日复牌至2008年12月31日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于2008年12月31日采用指数收益法估值。该股票于2009年1月8日打开跌停板，当日的收盘价为每股37.99元。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券，包括银行间市场债券正回购和交易所市场债券正回购。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,794,188,954.09	76.73
	其中：股票	1,794,188,954.09	76.73
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	533,477,419.01	22.81
6	其他资产	10,702,982.76	0.46
7	合计	2,338,369,355.86	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	60,302,662.64	2.62
B	采掘业	181,192,789.20	7.87
C	制造业	599,861,309.55	26.05
C0	食品、饮料	124,145,483.04	5.39
C1	纺织、服装、皮毛	15,703,314.99	0.68
C2	木材、家具	9,365,762.28	0.41
C3	造纸、印刷	40,923,222.71	1.78
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,280,993.00	0.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	70,305,127.60	3.05
C7	机械、设备、仪表	250,565,024.04	10.88
C8	医药、生物制品	68,395,900.80	2.97
C99	其他制造业	3,176,481.09	0.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,540,000.00	0.28
F	交通运输、仓储业	73,816,059.43	3.21
G	信息技术业	186,605,750.97	8.10
H	批发和零售贸易	216,964,448.14	9.42
I	金融、保险业	359,145,934.16	15.59
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	109,760,000.00	4.77
	合计	1,794,188,954.09	77.90

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600415	小商品城	2,000,000	109,760,000.00	4.77
2	600015	华夏银行	13,920,257	101,200,268.39	4.39
3	000937	金牛能源	6,800,754	95,210,556.00	4.13
4	000768	西飞国际	6,806,734	85,016,107.66	3.69
5	601318	中国平安	3,000,285	79,777,578.15	3.46
6	000759	武汉中百	7,469,258	70,211,025.20	3.05
7	600523	贵航股份	7,620,549	69,346,995.90	3.01
8	600030	中信证券	3,609,874	64,869,435.78	2.82
9	600195	中牧股份	5,509,854	64,795,883.04	2.81
10	600050	中国联通	12,000,000	60,360,000.00	2.62

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.hftfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600015	华夏银行	351,262,853.44	4.48
2	600030	中信证券	340,659,895.96	4.34
3	601318	中国平安	285,982,613.41	3.64
4	600000	浦发银行	276,705,379.40	3.53
5	600019	宝钢股份	254,030,004.62	3.24
6	000858	五粮液	249,381,571.30	3.18
7	600005	武钢股份	240,669,499.51	3.07
8	600383	金地集团	235,892,698.99	3.01
9	600050	中国联通	226,405,913.77	2.89
10	601398	工商银行	216,176,257.36	2.75
11	601166	兴业银行	199,835,978.09	2.55
12	000768	西飞国际	195,023,957.83	2.49
13	000002	万科A	191,310,054.85	2.44
14	600036	招商银行	164,032,366.95	2.09
15	600028	中国石化	161,468,685.28	2.06
16	601628	中国人寿	139,768,739.15	1.78
17	000061	农产品	131,911,550.70	1.68
18	000937	金牛能源	126,186,718.82	1.61
19	600523	贵航股份	121,133,224.44	1.54
20	000983	西山煤电	118,311,276.13	1.51

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	369,906,376.59	4.71
2	000858	五粮液	358,563,153.08	4.57
3	000002	万科A	349,772,332.18	4.46
4	600019	宝钢股份	331,772,820.23	4.23
5	600000	浦发银行	270,158,682.70	3.44
6	601318	中国平安	268,784,788.12	3.43
7	600383	金地集团	259,938,529.65	3.31
8	600963	岳阳纸业	251,777,382.30	3.21
9	000768	西飞国际	249,706,674.14	3.18
10	600309	烟台万华	218,230,123.89	2.78
11	600036	招商银行	217,434,998.81	2.77
12	600015	华夏银行	208,098,695.79	2.65
13	600875	东方电气	206,431,969.49	2.63
14	600519	贵州茅台	204,429,603.07	2.61
15	601166	兴业银行	182,152,154.40	2.32
16	000527	美的电器	182,027,187.04	2.32
17	600748	上实发展	160,925,882.95	2.05
18	601006	大秦铁路	157,308,640.85	2.00
19	600037	歌华有线	156,348,092.71	1.99
20	600583	海油工程	153,729,725.05	1.96

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,998,562,439.48
卖出股票收入（成交）总额	9,377,329,609.03

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	827,609.18
2	应收证券清算款	9,698,751.60
3	应收股利	-
4	应收利息	119,286.16
5	应收申购款	57,335.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,702,982.76

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000768	西飞国际	81,185,000.00	3.53	非公开发行

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
115,142	28,434.76	167,239,656.08	5.11%	3,106,795,056.06	94.89%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	13,912.33	0.000425%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年10月19日）基金份额总额	2,218,085,859.91
报告期期初基金份额总额	3,969,972,851.31
报告期期间基金总申购份额	1,450,821,925.77
报告期期间基金总赎回份额	-2,146,760,064.94
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	3,274,034,712.14

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准中国建设银行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度支付的审计费用是12万元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是3年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券回购	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	2	1,793,681,136.49	10.74%	-	-
中金公司	1	3,904,973,335.40	23.39%	1,020,000,000.00	78.79%
申银万国	1	1,626,646,303.45	9.74%	227,500,000.00	17.57%
中信证券	2	2,303,925,631.72	13.80%	-	-
招商证券	1	659,905,261.29	3.95%	-	-
中银国际	2	5,611,873,261.01	33.61%	47,000,000.00	3.63%
安信证券	1	704,183,750.80	4.22%	-	-
瑞银证券	1	93,382,617.77	0.56%	-	-

券商名称	权证交易		债券交易		应支付该券商的佣金		备注
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	-	-	-	-	1,473,388.30	10.38%	
中金公司	-	-	1,969,200.00	3.66%	3,319,225.39	23.38%	
申银万国	-	-	-	-	1,382,647.37	9.74%	
中信证券	-	-	-	-	1,911,221.57	13.46%	
招商证券	-	-	-	-	536,176.45	3.78%	
中银国际	181,333,430.79	100.00%	51,874,204.50	96.34%	4,898,633.05	34.50%	
安信证券	-	-	-	-	598,553.81	4.22%	
瑞银证券	-	-	-	-	79,376.11	0.56%	

注：报告期内本基金租用证券公司专用交易单元新增2个，分别是安信证券和瑞银证券上海证券交易所交易单元各1个。

（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

（2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司业务管理委员会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的业务管理委员会核准。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

（一）本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

1、2008年5月27日，中国建设银行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；

2、2008年9月23日，中国建设银行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份的公告；

3、2008年11月17日，中国建设银行公告美国银行公司行使认购期权的事宜；

4、2008年12月2日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：40088-40099

网址：www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司
二〇〇九年三月二十六日